

广发策略优选混合型证券投资基金 半年度报告

(2007 年上半年)

基金管理人：广发基金管理有限公司

基金托管人：中国工商银行股份有限公司

重要提示

本基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏,并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。本半年度报告已经三分之二以上独立董事签字同意,并由董事长签发。

本基金托管人——中国工商银行股份有限公司根据《广发策略优选混合型证券投资基金基金合同》(以下简称“本基金合同”)规定,于 2007 年 8 月 22 日复核了本报告中的财务指标、净值表现、财务会计报告、投资组合报告等内容,保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

本基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产,但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险,投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中的财务会计报告未经审计。

目录

重要提示.....	2
一、 基金简介.....	1
二、 主要财务指标和基金净值表现	2
三、 管理人报告.....	3
四、 托管人报告.....	5
五、 财务会计报告	6
六、 投资组合报告	19
七、 基金份额持有人户数、持有人结构	24
八、 基金份额变动情况	24
九、 重大事件揭示	24
十、 备查文件目录	28

一、基金简介

(一)基金产品概况

基金名称：广发策略优选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)

基金简称：广发优选

交易代码：270006

基金运作方式：契约型开放式

基金合同生效日：2006 年 5 月 17 日

报告期末基金份额： 6,609,013,809.09 份

投资目标：通过综合运用多种投资策略优选股票，分享中国经济和资本市场高速增长成果，为基金份额持有人谋求长期、稳定的回报。

投资策略：本基金将主要根据宏观经济政策、资金供求、市场波动周期因素判断，确定资产配置策略；通过综合运用主题投资、买入持有、逆向投资、等多种投资策略优选出投资价值较高的公司股票构建股票投资组合；通过利率预测以及收益曲线策略进行债券投资；同时严格遵守有关权证投资的比例限制。

业绩比较基准： 75%*新华富时 A600 指数+25%*新华雷曼中国全债指数

风险收益特征：较高风险，较高收益

(二)基金管理人及注册登记机构

名称：广发基金管理有限公司

注册地址：广东省珠海市凤凰北路 19 号农行商业大厦 1208 室

办公地址：广州市体育西路 57 号广东红盾大厦 14、15 楼

邮政编码：510620

法定代表人：马庆泉

信息披露负责人：兰惠艳

联系电话：020-83936666

传真：020-85586130

电子邮箱: lhy@gffunds.com.cn

(三) 基金托管人

名称: 中国工商银行股份有限公司

注册及办公地址: 北京市西城区复兴门内大街 55 号

邮政编码: 100032

法定代表人: 姜建清

信息披露负责人: 蒋松云

联系电话: 010-66106912

传真: 010-66106904

电子邮箱: custody@icbc.com.cn

(四) 本基金选定的信息披露报纸: 中国证券报、证券时报、上海证券报

投资者可以登陆本基金管理人互联网网址: <http://www.gffunds.com.cn> 查阅本基金半年度报告正文, 也可以到本基金管理人和托管人的办公地点查阅本基金半年度报告。

二、主要财务指标和基金净值表现

(一) 主要财务指标

单位: 人民币元

项 目	2007 年 1 月 1 日—6 月 30 日
基金本期净收益	6,991,293,819.47
基金份额本期净收益	0.8821
期末可供分配基金收益	4,173,714,070.80
期末可供分配基金份额收益	0.6315
期末基金资产净值	14,535,654,032.69
期末基金份额净值	2.1994
基金加权平均净值收益率	32.82%
本期基金份额净值增长率	75.47%
基金份额累计净值增长	155.50%

率	
---	--

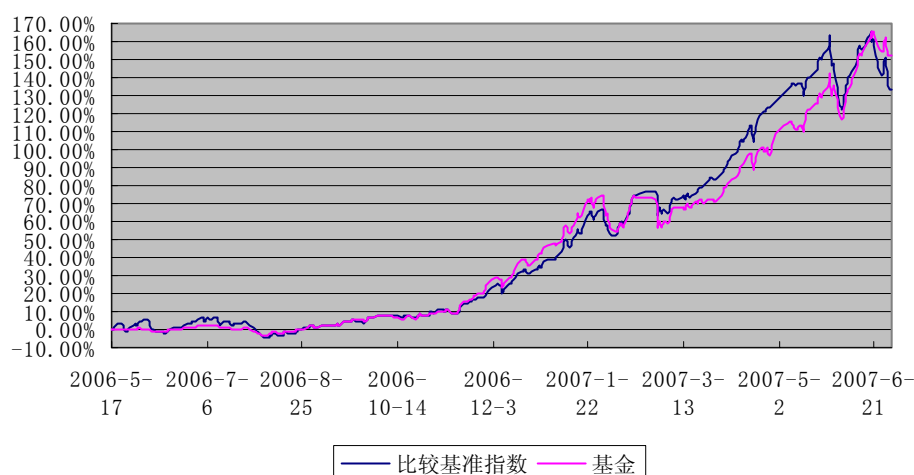
注：所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用，计入费用后实际收益水平要低于所列数字。

（二）基金净值表现

1、本基金本报告期单位基金净值增长率与同期业绩比较基准收益率比较表

阶 段	净值增长率(1)	净值增长率标准差(2)	业绩比较基准收益率(3)	业绩比较基准收益率标准差(4)	(1)-(3)	(2)-(4)
过去 3 个月	49.22%	0.0216	23.75%	0.0194	25.47%	0.0022
过去 6 个月	75.47%	0.0225	63.52%	0.0190	11.95%	0.0035
过去 1 年	152.00%	0.0173	121.08%	0.0152	30.92%	0.0021
自基金合同生效以来	155.50%	0.0163	133.65%	0.0150	21.85%	0.0013

2、本基金自基金合同生效以来单位基金资产净值的变动与同期业绩比较基准比较图



注：（1）业绩比较基准：65%*中信标普 300 指数收益+35%*中信标普国债指数收益。

（2）本基金图示时间段为2006年5月17日至2007年6月30日。

三、管理人报告

（一）基金管理人概况

本基金管理人由广发证券股份有限公司、广州科技风险投资有限公司、烽火通信科技股份有限公司、香江投资有限公司共同发起设立，经中国证监会证监基金字[2003]91 号文批准于 2003 年 8 月 5 日成立，目前实收资本为 1.2 亿元人民币。

本基金管理人在董事会下设合规审核委员会、薪酬与资格审查委员会、战略规

划委员会三个专业委员会。公司下设投资决策委员会、风险控制委员会和 14 个部门：投资管理部、研究发展部、市场拓展部、机构理财部、规划发展部、监察稽核部、风险控制部、综合管理部、财务部、人力资源部、信息技术部、注册登记部、中央交易室、基金会计部、金融工程部。此外，还设立了北京分公司、广州分公司和上海分公司。

截止到 2007 年 6 月 30 日，本基金管理人管理七只开放式基金——广发聚富证券投资基金、广发稳健增长证券投资基金、广发小盘成长证券投资基金、广发货币市场基金、广发聚丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金、广发大盘成长混合型证券投资基金，管理资产规模为 572.63 亿元。

（二）基金经理情况

何震，男，投资管理部副总经理，经济学硕士，14 年证券从业经历，曾任广发稳健增长基金基金经理、广发聚富开放式基金的基金经理助理，曾在广发证券股份有限公司、君安证券有限责任公司、海南富南国际信托投资公司从事研究工作。

（三）基金运作合规性声明

本报告期内，本基金管理人严格遵守《中华人民共和国证券投资基金法》及其配套法规、《广发策略优选混合型证券投资基金基金合同》和其他有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上，为基金持有人谋求最大利益。本报告期内，基金运作合法合规，无损害基金持有人利益的行为，基金的投资管理符合有关法规及基金合同的规定。

（四）基金运作及市场情况回顾与展望

1、市场回顾

本报告期内，A 股市场延续了 2006 年的牛市格局，前 5 个月单边上涨，5 月末进入大幅调整期。1 到 5 月份，在财富效应的吸引下，大量新的投资者一季度进入股市，他们带来的资金大多流向低价股，使得部分低价股的表现远超指数，相反以基金为代表的坚持价值投资的机构投资者在上半年的表现普遍不如指数表现。但是这种背离现象在报告期末得到纠正，没有基本面支撑的股票大幅度调整，有基本面支撑的股票表现强于大盘。

2、操作回顾

本基金管理人在资产配置上抓住人民币升值这条主线，重点配置金融、房地产等升值受惠行业，此外在机械、有色等行业景气度较高的行业也作了重点配置。上

半年在市场比较浮躁的前提下，本基金始终坚持以基本面为出发点来构建组合，没有被市场短时间的概念性炒作所诱惑，从价值投资和估值的角度出发，选择基本面良好的股票作为主要投资对象，最终还是取得了一定的效果。

3、后市展望

本基金管理人认为，在人民币长期升值以及中国经济快速增长的大背景下，A 股市场继续向好是必然的选择。但是我们还是希望市场能够保持慢牛格局，指数的上涨能够更稳健一些。我们认为二季度末 A 股市场的调整是良性的，来得非常及时，调整不改变牛市整体运行格局，却能延长牛市持续的时间。在调整的过程中，个股结构分化将是主旋律。本基金管理人将着重选择成长性良好，估值相对合理的个股，在行业选择上，金融、地产、商业零售等受益于人民币升值的行业，以及机械制造、资源等景气度良好的行业将是主要的关注对象。

四、托管人报告

2007年上半年，本基金托管人在对广发策略优选混合型证券投资基金的托管过程中，严格遵守《证券投资基金法》及其他法律法规和基金合同的有关规定，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，完全尽职尽责地履行了基金托管人应尽的义务。

2007年上半年，广发策略优选混合型证券投资基金的管理人——广发基金管理有限公司在广发策略优选混合型证券投资基金的投资运作、基金资产净值计算、基金份额申购赎回价格计算、基金费用开支等问题上，不存在任何损害基金份额持有人利益的行为，在各重要方面的运作严格按照基金合同的规定进行。

2007年上半年，广发策略优选混合型证券投资基金因证券市场波动发生过不符合《证券投资基金运作管理办法》或基金合同所规定的投资比例限制的情况，广发基金管理有限公司经本托管人以函件形式提示后，在法律法规规定的期限内，及时对广发策略优选混合型证券投资基金的投资组合进行了调整。

本托管人依法对广发基金管理有限公司在2007年上半年所编制和披露的广发策略优选混合型证券投资基金年度报告中财务指标、净值表现、收益分配情况、财务会计报告、投资组合报告等内容进行了核查，以上内容真实、准确和完整。

中国工商银行股份有限公司资产托管部

2007 年 8 月 22 日

五、财务会计报告

(一) 基金会计报表

资产负债表

(2007 年 6 月 30 日)

金额单位：人民币元

项 目	附注	2007-6-30	2006-12-31
资产：			
银行存款		972,163,202.24	1,053,065,533.21
清算备付金		11,395,203.06	22,073,540.37
交易保证金		8,049,036.07	1,750,000.00
应收证券款		0.00	218,343,812.51
应收股利		16,693,961.02	
应收利息	4(1)	268,566.65	2,221,087.45
应收申购款		160,854,991.57	24,077,582.43
其他应收款		0.00	0.00
股票投资市值	4(2)	13,495,668,505.73	18,107,744,714.62
其中：股票投资成本		6,739,697,404.16	11,978,408,919.60
债券投资市值			209,051,917.91
其中：债券投资成本			181,034,900.00
权证投资		134,911,460.03	52,217,753.70
买入返售证券			
待摊费用			
其他资产			
资产合计		14,800,004,926.37	19,690,545,942.20
负债与基金持有人权益			
应付证券款		191,642,685.51	0.00
应付赎回款		44,517,591.23	349,980,741.91
应付赎回费		159,912.75	1,643,962.86
应付管理人报酬		16,480,850.98	24,319,109.19
应付托管费		2,746,808.5	4,053,184.84
应付佣金	4(3)	6,834,852.83	8,155,504.95
应付利息		0.00	
应付收益		0.00	
未交扣金		0.00	

其他应付款	4(4)	1,750,000.00	1,754,775.00
卖出回购证券款		0.00	
短期借款		0.00	
预提费用	4(5)	218,191.88	220,000.00
其他负债			
负债合计		264,350,893.68	390,127,278.75
持有人权益：			
实收基金	4(6)	6,609,013,809.09	13,254,816,762.31
未实现利得	4(7)	3,752,926,152.80	5,293,973,420.81
未分配收益		4,173,714,070.80	751,628,480.33
持有人权益合计		14,535,654,032.69	19,300,418,663.45
负债及持有人权益合计		14,800,004,926.37	19,690,545,942.20

经营业绩表

(2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日期间)

金额单位：人民币元

项 目	附 注	2007 年 1 月 1 日—6 月 30 日
一、已实现基金收入		7,116,291,543.05
其中：股票差价收入	4(8)	7,042,425,184.13
债券差价收入	4(9)	-3,997,433.10
权证差价收入	4(10)	1,696,922.64
债券利息收入		174,526.13
存款利息收入		4,266,360.68
股利收入		52,722,969.01
买入返售证券收入		
其他收入	4(11)	19,003,013.56
减：基金费用		124,997,723.58
其中：基金管理人报酬		106,919,952.22
基金托管费		17,819,992.04
卖出回购证券支出		0.00
利息支出		0.00
其他费用	4(12)	257,779.32
其中：交易费用		0.00
信息披露费		178,520.30
审计费用		39,671.58
其他		39,587.44
二、已实现基金收益		6,991,293,819.47
加：未实现利得		681,311,994.97
三、基金经营业绩		7,672,605,814.44

收益分配表

(2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日期间)

金额单位：人民币元

项 目	附注	2007 年 1 月 1 日-6 月 30 日
本期基金净收益		6,991,293,819.47
加： 期初基金净收益		751,628,480.33
加： 本期损益平准金		-1,696,889,340.16
可供分配基金净收益		6,046,032,959.64
减： 本期已分配基金净收益	4(13)	1,872,318,888.84
期末基金净收益		4,173,714,070.80

基金净值变动表

(2007 年 1 月 1 日至 2007 年 6 月 30 日期间)

金额单位：人民币元

项 目	2007 年 1 月 1 日-6 月 30 日
一、期初基金净值	19,300,418,663.45
二、本期经营活动	
基金净收益	6,991,293,819.47
未实现利得	681,311,994.97
经营活动产生的基金净值变动数	7,672,605,814.44
三、本期基金份额交易	
基金申购款	5,112,288,929.17
基金赎回款	-15,677,340,485.53
基金份额交易产生的基金净值变动数	-10,565,051,556.36
四、本期向持有人分配收益	
向持有人分配收益产生基金净值变动数	-1,872,318,888.84
五、以前年度损益调整	
因损益调整产生的净值变动数	
六、期末基金净值	14,535,654,032.69

(二) 会计报表附注

1、基金简介

广发策略优选混合型证券投资基金(以下简称“本基金”)经证监基金字[2006]72号《关于同意广发策略优选混合型证券投资基金募集的批复》批准,由基金发起人广发基金管理有限公司依照《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发策略优选混合型证券投资基金基金合同》发起,于2006年5月17日募集成立。本基金的基金管理人为广发基金管理有限公司,基金托管人为中国工商银行股份有限公司。本基金已向中国证券监督管理委员会备案,并获中国证监会基金部函[2006]103号《关于广发策略优选混合型证券投资基金备案确认的函》确认。

本基金募集期为2006年5月8日至2006年5月15日,本基金为契约型开放式混合型基金,存续期限不定,首次募集资金为18,417,976,676.64元,有效认购户数为296,219户。其中,认购款项在基金验资确认日前产生的利息共计人民币1,560,143.78元,利息结转的基金份额1,560,143.78份,按照《广发策略优选混合型证券投资基金基金合同》的有关约定计入投资者基金账户。本基金募集资金经深圳市鹏城会计师事务所有限公司验资。基金合同于2006年5月17日生效,基金合同生效日的基金份额总额为18,417,976,676.64份。

根据《中华人民共和国证券投资基金法》、《证券投资基金运作管理办法》等有关规定和《广发策略优选混合型证券投资基金基金合同》的有关规定,本基金的投资范围为具有良好流动性的金融工具,包括国内依法发行上市的股票、债券、权证及法律、法规或中国证监会允许基金投资的其他金融工具。

2、主要会计政策

(1) 会计报表编制基础

本基金的会计报表乃按照《企业会计准则》、《金融企业会计制度》、《证券投资基金会计核算办法》、中国证券监督管理委员会颁布的《证券投资基金信息披露管理办法》、《证券投资基金信息披露内容与格式准则》第3号《半年度报告的内容与格式》和《证券投资基金信息披露编报规则》第3号《会计报表附注的编制及披露》的规定而编制。

(2) 会计年度

本基金的会计年度为公历1月1日至12月31日止。本报告会计报表实际编制期间为2007年1月1日至2007年6月30日止。

(3) 记帐本位币

本基金以人民币为记帐本位币。

（4）记帐基础和计价原则

本基金的会计核算以权责发生制为记帐基础，除股票投资和债券投资及权证投资按本附注所述的估值方法计价外，其他所有报表项目均按历史成本计价。

（5）基金资产的估值方法

上市流通的股票，以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，以最近交易日的市价（收盘价）估值。

在证券交易所市场流通的债券，实行净价交易的债券按估值日收盘价估值；估值日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；未实行净价交易的债券按估值日收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值；估值日没有交易的，按最近交易日债券收盘价减去债券收盘价中所含的债券应收利息得到的净价进行估值。

配股和增发新股，按估值日在证券交易所挂牌的同一股票的市价（收盘价）估值；估值日无交易的，以最近交易日的市价（收盘价）估值。

上市交易流通的权证，以其估值日在证券交易所挂牌的市价（收盘价）估值；当日没有交易的，按最近交易日的收盘价估值；未上市交易的权证，以能反映权证公允价值的价格估值。

首次公开发行的股票，按成本估值。

未上市债券按成本估值。

银行间同业市场交易的债券，按购入成本估值。

可转换债，按交易所提供的该证券收盘价（减应收利息）进行估值。

如有确凿证据表明按上述方法进行估值不能客观反映其公允价值的，基金管理人可根据具体情况与基金托管人商定后，按最能反映公允价值的价格估值。

如有新增事项，按国家最新规定估值。

估值对象为基金所拥有的股票、国债、股息红利、债券利息和银行存款本息等资产。

（6）证券投资的成本计价方法

按加权移动平均法计算库存证券的成本。当日有买入和卖出时，先计算成本后计算买卖证券价差。

股票：

买入股票于成交日确认为股票投资。股票投资成本按成交日应支付的全部价款入账。

a. 上交所买入股票成本：由买入金额、买入印花税、买入过户费、买入经手费、买入证管费和买入佣金组成；

b. 深交所买入股票成本：由买入金额、买入印花税、买入经手费和买入佣金组成；

c. 因股权分置改革而获得的非流通股股东支付的现金对价于股权分置改革实施后的股票复牌日冲减其股票投资成本。

债券：

a. 买入上市债券按应支付的全部价款入账，如果应支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

b. 买入非上市债券按实际支付的全部价款入账，如果实际支付的价款中包含债券起息日或上次除息日至购买日止的利息，作为应收利息单独核算，不构成债券投资成本；

c. 债券买卖不计佣金；

权证：

买入权证于成交日确认为权证投资，权证投资成本按成交日应支付的全部价款入账；

由股权分置改革而被动获得的权证，在确认日记录所获分配的权证数量，权证初始成本为零。

买入返售证券：

买入返售证券成本：通过证券交易所进行融券业务，按成交日扣除手续费后的应付金额确认买入返售证券投资；通过银行间市场进行融券业务，按实际支付的价款确认买入返售证券投资。

(7) 待摊费用的摊销方法和摊销期限

待摊费用按直线法在受益期内平均摊销。

(8) 收入的确认和计量

股票差价收入于卖出股票成交日确认，并按卖出股票成交总额与其成本和相关费用的差额入账；

债券差价收入：

卖出交易所上市债券，于成交日确认债券差价收入，并按应收取的全部价款与其成本、应收利息和相关费用的差额入账；

卖出银行间市场交易债券，于实际收到价款时确认债券差价收入，并按实际收到的全部价款与其成本、应收利息的差额入账；

权证差价收入：

卖出权证，于成交日确认权证差价收入，并按卖出权证成交总额与其成本和相关费用的差额入账；

债券利息收入按债券票面价值与票面利率或内含票面利率计算的金额扣除适用情况下应由债券发行企业代扣代缴的个人所得税后的净额确认，在债券实际持有期内逐日计提；

存款利息收入按本金与适用的利率逐日计提的金额入账；

股利收入于除息日确认，并按上市公司宣告的分红派息比例计算的金额入账；

买入返售证券收入按证券持有期内采用直线法逐日计提的金额入账；

其他收入于实际收到时确认收入。

（9） 费用的确认和计量

基金管理费按照前一日基金资产净值 1.5%的年费率逐日计提；

基金托管费按照前一日基金资产净值 0.25%的年费率逐日计提；

卖出回购证券支出按融入资金额及约定利率，在回购期限内采用直线法逐日计提。

（10） 基金的收益分配政策

基金收益分配比例为基金净收益的 100%；

基金收益分配方式分两种：现金分红与红利再投资，投资人可选择现金红利或将现金红利按红利发放日的基金份额净值自动转为基金份额进行再投资；若投资者不选择，本基金默认的收益分配方式是现金分红；当投资者的现金红利小于一定金额，不足以支付银行转账或其他手续费用时，基金注册登记人可将投资者的现金红利按红利发放日的单位基金资产净值基金份额净值自动转为基金单位份额，除以上情况，在投资者选择现金分红时，不得将红利再投资。

在符合有关基金分红条件的前提下，基金收益每年至少分配一次，但若成立不满 3 个月可不进行收益分配，年度分配在基金会计年度结束后的 4 个月内完成；

基金当年收益先弥补基金上一年度亏损后，方可进行当年收益分配；

如果基金投资当期出现亏损，则基金当年不进行收益分配；

基金收益分配后基金份额净值不能低于面值；

法律法规或监管机关另有规定的，从其规定。

(11) 基金申购、赎回的确认

在收到基金投资人申购或赎回申请之日后，于下一个工作日内对该交易的有效性进行确认。于确认日按照实收基金、未实现利得、未分配收益和损益平准金的余额占基金净值的比例，将确认有效的申购或赎回款项分割为三部分，分别确认为实收基金、未实现利得、损益平准金的增加或减少。

(12) 实收基金

每份基金份额面值为 1.00 元。实收基金为对外发行的基金份额总额。由于申购、赎回引起的实收基金的变动分别于基金申购确认日、赎回确认日列示。

(13) 损益平准金

损益平准金为申购、赎回款中所含的按基金未分配净收益占基金净值比例计算的一部分金额，于计算基金申购、赎回确认日列示，并于期末全额转入未分配收益。

3、主要税项

(1) 印花税

根据财政部、国家税务总局关于调整证券(股票)交易印花税税率的通知,自 2007 年 5 月 30 日起,基金管理人运用基金买卖股票按照 3%的税率征收印花税。在此之前,2005 年 1 月 24 日至 2007 年 5 月 29 日期间,按 1%的税率征收印花税,2005 年 1 月 24 日之前,均按 2%的税率征收印花税。

(2) 营业税、企业所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128 号文《关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》，以发行基金方式募集资金不属于营业税的征税范围，不征收营业税；根据财政部、国家税务总局财税字[2004]78 号文《关于证券投资基金税收政策的通知》，自 2004 年 1 月 1 日起，基金管理人运用基金买卖股票、债券的差价收入，继续免征营业税和企业所得税。

(3) 个人所得税

根据财政部、国家税务总局财税字[2002]128号文《财政部、国家税务总局关于开放式证券投资基金有关税收问题的通知》的规定,本基金取得的股票的股息、红利

收入及企业债券的利息收入,由上市公司及债券发行企业在向其派发股息、红利收入和利息收入时代扣代缴20%的个人所得税。根据财政部、国家税务总局[2005]102号文《关于股息红利有关个人所得税有关政策的通知》与财税字[2005]107号文《关于股息红利有关个人所得税政策的补充通知》,对本基金自2005年6月13日起从上市公司分配取得的股息红利所得,扣缴义务人在代扣代缴个人所得税时,减按50%计算应纳税所得额。

4、主要报表项目说明

金额单位:人民币元

(1) 应收利息

应收利息明细项目列示如下:

项 目	2007 年 6 月 30 日
应收银行存款利息	220,841.65
应收备付金利息	4,615.02
应收认申购款利息	43,109.98
合 计	268,566.65

(2) 投资估值增值

项 目	2007 年 6 月 30 日
股票投资估值增值	6,755,971,101.57
权证投资估值增值	109,643,353.42
合 计	6,865,614,454.99

(3) 应付佣金

项 目	2007 年 6 月 30 日
广发证券股份有限公司	822,093.59
广发华福证券有限责任公司	17,603.4
国元证券股份有限公司	1,973,532.97
招商证券股份有限公司	483,693.86
银河证券股份有限公司	522,197.5
光大证券股份有限公司	492,733.74
高华证券有限责任公司	869,990.39
东北证券有限责任公司	166,484.9
中信证券股份有限公司	609,826.26
国信证券股份有限公司	466,553.16
湘财证券股份有限公司	410,143.06
合计	6,834,852.83

(4) 其他应付款

项 目	2007 年 6 月 30 日
应付券商交易保证金	1,750,000.00
合 计	1,750,000.00

(5) 预提费用

项 目	2007 年 6 月 30 日
审计费用	39,671.58
信息披露费用	178,520.3
合计	218,191.88

(6) 实收基金

项 目	2007 年 6 月 30 日
期初数	13,254,816,762.31
加：本期因申购的增 加数	2,486,476,396.82
减：本期因赎回的减 少数	9,132,279,350.04
期末数	6,609,013,809.09

(7) 未实现利得

项 目	2007 年 6 月 30 日
期初数	5,293,973,420.81
加：投资估值增值	571,668,641.55
加：权证估值增值	109,643,353.42
本期申购的未实现利得 平准金	1,228,485,651.33
减：本期赎回的未实现利 得平准金	3,450,844,914.31
期末数	3,752,926,152.80

(8) 股票差价收入

项 目	2007 年 1 月 1 日—6 月 30 日
股票成交金额(1)	17,276,880,941.15
股票成本总额(2)	10,219,945,918.31
应付佣金(3)	14,509,838.71
股票差价收入(1)－ (2)－(3)	7,042,425,184.13

(9) 债券差价收入

项 目	2007 年 1 月 1 日—6 月 30 日
债券成交金额(1)	155,794,407.62
债券成本总额(2)	157,849,524.64
应收利息(3)	1,942,316.08
债券差价收入(1)－ (2)－(3)	-3,997,433.10

(10) 权证差价收入

项 目	2007 年 1 月 1 日—6 月 30 日
卖出权证成交总额	1,696,922.64
减：卖出权证成本总额	
应付佣金	
权证差价收入	1,696,922.64

(11) 其他收入

其他收入主要包括赎回费收入和新股手续费返还款项。

项 目	2007 年 1 月 1 日—6 月 30 日
赎回费收入	18,389,975.63
新股手续费返还	0
转换费收入	613,037.93
合计	19,003,013.56

(12) 其他费用

其他费用主要包括信息披露费用、审计费和回购手续费等其他费用。

项 目	2007 年 1 月 1 日—6 月 30 日
信息披露费	178,520.3
审计费用	39,671.58
其他	39,587.44
合 计	257,779.32

(13) 本期已分配基金净收益

本基金本报告期分红 3 次，每基金份额分配 0.60 元。本期已分配基金净收益为 1,872,318,888.84 元。明细列示如下：

除权日期	金额
2007-4-24	177,425,183.45
2007-5-24	1,106,191,661.33
2007-6-15	588,702,044.06
合 计	1,872,318,888.84

5、主要关联交易及其关联方

(1) 关联方关系

关联方名称	与本基金的关系
-------	---------

广发基金管理有限公司	基金发起人、基金管理人、注册登记与过户机构、直销机构
中国工商银行股份有限公司	基金托管人、代销机构
广发证券股份有限公司	基金管理人股东、代销机构
广州科技风险投资有限公司	基金管理人的股东
烽火通信科技股份有限公司	基金管理人的股东
香江投资有限公司	基金管理人的股东
广发华福证券有限责任公司	基金管理人股东的子公司
广发期货经纪有限公司	基金管理人股东子公司
广发北方证券经纪有限责任公司	基金管理人股东的子公司

(2) 通过关联席位进行的交易

金额单位:人民币元

2007 年 1 月 1 日—6 月 30 日本基金通过关联方席位的股票、债券和权证成交量以及回购交易量

a. 2007 年 1 月 1 日—6 月 30 日本基金通过关联方席位的股票、债券和权证成交量

关联方	交易量			占总交易量比例				
	股票	债券	权证	股票	债券	权证	佣金	占总佣金比例
广发证券股份有限公司	5,333,464,412.38	0.00	0.00	23.98%	0.00	0.00	4,314,319.86	24.01%
广发华福证券有限责任公司	2,253,197,916.86	0.00	0.00	10.13%	0.00	0.00	1,763,136.33	9.81%
合 计	7,586,662,329.24	0.00	0.00	34.11%	0.00	0.00	6,077,456.19	33.82%

b. 2007 年 1 月 1 日—6 月 30 日本基金未通过关联方席位进行债券交易。

股票交易佣金的计提标准: 支付佣金=股票成交金额*佣金比例-证管费-经手费-结算风险金(含债券交易)。

上述佣金按市场佣金率计算, 佣金比率是公允的。

根据《证券研究服务协议》, 本基金管理人从关联方获得证券研究综合服务。

(3) 基金管理人报酬

基金管理费按前一日的基金资产净值的 1.5 %的年费率计提。计算方法如下:

$$H=E \times 1.5\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金管理费

E 为前一日的基金资产净值

基金管理费每日计提，按月支付，由基金管理人向基金托管人发送基金管理费划付指令，基金托管人复核后于次月首三个工作日内从基金资产中一次性支付给基金管理人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。本基金本期计提管理人报酬为 106,919,952.22 元。

(4) 基金托管人费用

基金托管费按前一日的基金资产净值的 0.25% 的年费率计提。计算方法如下：

$$H = E \times 0.25\% \div \text{当年天数}$$

H 为每日应支付的基金托管费

E 为前一日的基金资产净值

基金托管费每日计提，按月支付。由基金管理人向基金托管人发送基金托管费划付指令，基金托管人复核后于次月首三个工作日内从基金资产中一次性支付给基金托管人。若遇法定节假日、休息日等，支付日期顺延。本期计提托管人报酬为 17,819,992.04 元。

(5) 由关联方保管的银行存款余额和当期产生的利息收入

本基金的银行存款由基金托管人中国工商银行股份有限公司保管，并且按照银行间同业利率计息：

时间	关联方名称	期末保存银行存款余额	当期产生的利息收入
2007.06.30	中国工商银行股份有限公司	972,163,202.24	4,266,360.68

(6) 关联方持有的基金份额

关联方名称	期末持有基金份额	占基金总份额的比例
广发基金管理有限公司	22,732,439.19	0.34%

6、流通受到限制的基金资产

本基金截至2007年6月30日止，因非公开发行流通受限制的股票情况如下：

股票名称	申购方式	申购确认日	数量(股)	成本(元)	市值(元)
中信国安	网下申购	2006.08.22	8,000,000	96,000,000.00	224,000,000.00
津滨发展	网下申购	2006.08.24	34,000,000	118,320,000.00	508,640,000.00
宝钛股份	网下申购	2006.09.12	5,400,000	93,000,000.00	230,634,000.00
长江精工	网下申购	2006.09.29	5,000,000	25,400,000.00	51,200,000.00
卧龙电气	网下申购	2006.07.10	9,900,000	50,400,000.00	97,911,000.00
安徽合力	网下申购	2006.07.06	2,200,000	23,320,000.00	62,700,000.00

本基金截至2007年6月30日止，因公布重大事项流通受限制的股票情况如下：

股票名称	数量(股)	成本(元)	市值(元)
农产品	5,908,299	58,374,250.27	129,391,748.10
陆家嘴	11,232,918	180,093,640.37	285,428,446.38
王府井	4,580,486	79,466,601.14	225,130,886.90
世茂股份	5,044,961	125,581,225.08	132,177,978.20

六、投资组合报告

(一) 基金资产配置组合

	市值(元)	占总资产的比重
股票	13,495,668,505.73	91.19%
债券	0.00	0.00%
权证	134,911,460.03	0.91%
银行存款和清算备付金	983,558,405.30	6.65%
其他资产	185,866,555.31	1.25%
合计	14,800,004,926.37	100%

(二) 按行业分类的股票投资组合

行业	市值(元)	市值占净值比
A 农、林、牧、渔业	0.00	0.00%
B 采掘业	443,254,080.90	3.05%
C 制造业	6,509,404,863.31	44.78%
C0 食品、饮料	1,686,354,525.32	11.60%
C1 纺织、服装、皮毛	0.00	0.00%
C2 木材、家具	337,897,418.30	2.32%
C3 造纸、印刷	55,818,392.26	0.38%
C4 石油、化学、塑胶、塑料	282,014,043.18	1.94%
C5 电子	430,340,579.88	2.96%
C6 金属、非金属	1,788,811,777.84	12.31%
C7 机械、设备、仪表	1,837,713,260.13	12.64%
C8 医药、生物制品	73,921,975.84	0.51%

C99 其他制造业	16,532,890.56	0.11%
	0.00	0.00%
D 电力、煤气及水的生产和供应业	301,741,735.68	2.08%
E 建筑业	51,200,000.00	0.35%
F 交通运输、仓储业	180,314,716.78	1.24%
G 信息技术业	340,341,806.20	2.34%
H 批发和零售贸易	859,445,105.60	5.91%
I 金融、保险业	1,719,316,624.90	11.83%
J 房地产业	2,065,175,997.32	14.21%
K 社会服务业	508,640,000.00	3.50%
L 传播与文化产业	222,253,846.65	1.53%
M 综合类	294,579,728.39	2.03%
合计	13,495,668,505.73	92.85%

(三) 本基金持有的所有股票明细

证券代码	证券名称	库存数量	证券市值	市值占净值%
600000	浦发银行	27,231,320	996,393,998.80	6.85%
600519	贵州茅台	7,707,236	922,402,004.48	6.35%
600048	保利地产	15,700,000	721,101,000.00	4.96%
600005	武钢股份	51,800,000	521,108,000.00	3.59%
000001	深发展 A	18,801,904	517,428,398.08	3.56%
000897	津滨发展	34,000,000	508,640,000.00	3.50%
600694	大商股份	8,203,452	504,922,470.60	3.47%
000568	泸州老窖	11,605,212	488,579,425.20	3.36%
000024	招商地产	9,700,565	476,297,741.50	3.28%
002008	大族激光	15,655,200	356,155,800.00	2.45%
000983	西山煤电	12,200,000	344,406,000.00	2.37%
600585	海螺水泥	5,698,150	335,962,924.00	2.31%
600150	沪东重机	2,338,324	323,249,909.76	2.22%
600456	宝钛股份	94,959,670	314,331,505.70	2.16%
600900	长江电力	19,956,464	301,741,735.68	2.08%
000839	中信国安	10,754,285	301,119,980.00	2.07%
600663	陆家嘴	11,232,918	285,428,446.38	1.96%
000338	潍柴动力	3,370,516	264,585,506.00	1.82%
600786	东方锅炉	3,989,652	251,268,282.96	1.73%
000895	S 双 汇	4,069,301	235,612,527.90	1.62%
600859	王府井	4,580,486	225,130,886.90	1.55%
600383	金地集团	6,537,614	223,717,151.08	1.54%

000917	电广传媒	14,966,589	222,253,846.65	1.53%
600978	宜华木业	7,041,278	219,335,809.70	1.51%
000778	新兴铸管	14,324,930	196,108,291.70	1.35%
601919	中国远洋	8,451,003	154,315,314.78	1.06%
600685	广船国际	3,014,091	151,518,354.57	1.04%
600331	宏达股份	3,084,670	149,452,261.50	1.03%
000046	泛海建设	4,300,000	148,307,000.00	1.02%
600858	银座股份	4,576,481	140,360,672.27	0.97%
000698	沈阳化工	11,751,931	132,561,781.68	0.91%
600823	世茂股份	5,044,961	132,177,978.20	0.91%
000061	农产品	5,908,299	129,391,748.10	0.89%
000878	云南铜业	3,704,537	127,806,526.50	0.88%
600337	美克股份	5,340,613	118,561,608.60	0.82%
600290	华仪电气	2,496,265	115,002,928.55	0.79%
600169	太原重工	4,879,001	111,533,962.86	0.77%
600582	天地科技	1,864,466	111,215,396.90	0.77%
601166	兴业银行	2,999,978	105,269,228.02	0.72%
600416	湘电股份	3,486,406	104,661,908.12	0.72%
600022	济南钢铁	7,483,267	98,180,463.04	0.68%
600580	卧龙电气	9,900,000	97,911,000.00	0.67%
600790	轻纺城	8,229,996	90,283,056.12	0.62%
002128	露天煤业	2,371,969	85,628,080.90	0.59%
600082	海泰发展	5,979,088	78,146,680.16	0.54%
000898	鞍钢股份	4,253,312	75,241,089.28	0.52%
600036	招商银行	3,000,000	73,740,000.00	0.51%
600360	华微电子	3,339,999	67,200,779.88	0.46%
600895	张江高科	3,700,000	63,936,000.00	0.44%
002009	天奇股份	3,387,879	63,929,276.73	0.44%
600761	安徽合力	2,200,000	62,700,000.00	0.43%
000657	中钨高新	5,417,733	62,303,929.50	0.43%
000935	四川双马	3,892,793	57,769,048.12	0.40%
600963	岳阳纸业	2,194,982	55,818,392.26	0.38%
600496	长江精工	5,000,000	51,200,000.00	0.35%
000908	S 天一科	2,767,820	47,966,320.60	0.33%
000425	徐工科技	3,736,400	45,770,900.00	0.31%
600062	双鹤药业	2,398,212	43,335,690.84	0.30%
002093	国脉科技	635,686	39,221,826.20	0.27%
000999	S 三 九	1,689,850	30,586,285.00	0.21%
600835	上海机电	1,100,761	27,320,888.02	0.19%
600030	中信证券	500,000	26,485,000.00	0.18%
600087	南京水运	1,999,954	25,999,402.00	0.18%
600550	天威保变	870,278	23,767,292.18	0.16%
600809	山西汾酒	700,000	23,506,000.00	0.16%

600673	阳之光	1,064,686	20,069,331.10	0.14%
600612	第一铅笔	930,906	16,532,890.56	0.11%
000930	丰原生化	2,535,814	16,254,567.74	0.11%
600560	金自天正	1,384,378	15,242,001.78	0.10%
600028	中国石化	1,000,000	13,220,000.00	0.09%
002045	广州国光	600,000	6,984,000.00	0.05%

(四) 报告期内股票投资组合的重大变动

本报告期累计买入金额最大的前 20 名股票：			
股票代码	股票名称	累计买入金额	占净值比 (%)
600900	长江电力	311,181,161.31	1.61%
000898	鞍钢股份	282,814,560.60	1.47%
000983	西山煤电	232,642,737.64	1.21%
600663	陆家嘴	217,264,352.11	1.13%
000917	电广传媒	203,611,377.26	1.05%
601628	中国人寿	175,453,137.50	0.91%
600008	首创股份	169,459,701.06	0.88%
000568	泸州老窖	169,063,375.96	0.88%
000698	沈阳化工	148,887,563.54	0.77%
601919	中国远洋	144,520,196.22	0.75%
600858	银座股份	140,793,899.51	0.73%
000878	云南铜业	131,461,710.00	0.68%
600000	浦发银行	126,393,954.83	0.65%
600823	世茂股份	125,581,225.08	0.65%
600331	宏达股份	121,029,317.91	0.63%
000778	新兴铸管	115,284,612.01	0.60%
601166	兴业银行	107,777,401.14	0.56%
000425	徐工科技	90,122,115.09	0.47%
600290	华仪电气	89,632,566.21	0.46%
000839	中信国安	89,531,799.45	0.46%
本报告期内累计卖出金额最大的前 20 名股票：			
股票代码	股票名称	累计卖出金额	占净值比 (%)
600050	中国联通	965,056,971.70	5.00%
600028	中国石化	882,889,016.98	4.57%
000402	金融街	784,187,956.74	4.06%
601600	中国铝业	729,522,484.43	3.78%
600036	招商银行	687,049,872.52	3.56%
600900	长江电力	620,137,288.51	3.21%
600019	宝钢股份	521,256,979.70	2.70%
600309	烟台万华	507,463,837.82	2.63%
600005	武钢股份	506,396,536.91	2.62%
000792	盐湖钾肥	452,330,720.41	2.34%
002024	苏宁电器	418,944,656.86	2.17%
600583	海油工程	355,851,582.50	1.84%
000046	泛海建设	307,748,068.31	1.59%

600383	金地集团	291,191,032.97	1.51%
600009	上海机场	290,691,083.78	1.51%
600694	大商股份	238,593,369.69	1.24%
600037	歌华有线	236,314,712.11	1.22%
601988	中国银行	233,637,949.13	1.21%
600585	海螺水泥	223,242,547.05	1.16%
601006	大秦铁路	222,387,531.03	1.15%
报告期内买入股票总成本:		4,981,234,402.87	
报告期内卖出股票收入总额		17,276,880,941.15	

(五) 本报告期末持有债券投资。

(六) 投资组合报告附注

- 1、本基金持有的每只股票的价值均不超过基金资产净值的 10%。
- 2、报告期内本基金投资的前十名股票的发行主体未被监管部门立案调查，或在本报告编制日前一年内本基金投资的前十名证券的发行主体未受到公开谴责和处罚。
- 3、本基金投资的前十名股票均未超出基金合同规定的备选股票库。
- 4、本基金本报告期其他资产的构成包括交易保证金 8,049,036.07 元, 应收股利 16,693,961.02 元, 应收利息 268,566.65 元, 应收申购款 160,854,991.57 元, 合计为 185,866,555.31 元。
- 5、截至 2007 年 6 月 30 日，本基金未持有处于转股期的可转换债券。
- 6、本报告期末本基金所持有的权证投资，其数量与成本总额列示如下：

被动投资			
权证代码	权证名称	权证数量（份）	成本总额(元)
031003	深发 SFC1	1,880,190	0.00
031004	深发 SFC2	940,095	0.00
580009	伊利 CWB1	1,158,952	0.00

主动投资			
权证代码	权证名称	权证数量（份）	成本总额(元)
30002	五粮 YGC1	2,000,000	25,268,106.61

7、本报告期本基金未持有资产支持证券。

七、基金份额持有人户数、持有人结构

期末有效户数	155,905
期末平均每户持有基金份额	42,391.29
期末机构投资者持有份额	342,365,602.26
期末机构投资者所占比例	5.18%
期末个人投资者持有份额	6,266,648,206.83
期末个人投资者所占比例	94.82%
本基金管理人从业人员持有份额	0
本基金管理人从业人员所占比例	0

八、基金份额变动情况

合同生效日基金总份额	18,417,976,676.64
期初余额	13,254,816,762.31
期内申购总份额	2,486,476,396.82
期内赎回总份额	9,132,279,350.04
期末余额	6,609,013,809.09

九、重大事件揭示

- （一）本报告期内未召开基金份额持有人大会。
- （二）在本报告期内未发生涉及本基金管理人、基金财产及基金托管业务的诉

讼事项。

（三）在本报告期内本基金的投资组合策略没有重大改变。

（四）本基金管理人于 2007 年 1 月 6 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告，增加招商银行股份有限公司为本基金的代理销售机构。

（五）本基金管理人于 2007 年 2 月 3 日在《中国证券报》发布北京分公司和上海分公司地址变更的公告。

（六）本基金管理人于 2007 年 2 月 3 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告，持农行金穗借记卡的个人投资者通过网上交易方式认购或申购本公司旗下偏股基金统一适用 0.6% 的优惠费率（仅限于前端收费模式）。

（七）本基金管理人于 2007 年 2 月 13 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告，增加上海浦东发展银行股份有限公司为本基金的代理销售机构并在上海浦东发展银行股份有限公司推出本基金的定期定额投资业务。

（八）本基金管理人于 2007 年 3 月 16 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告，增加交通银行股份有限公司为本基金的代理销售机构并在交通银行股份有限公司推出本基金的定期定额投资业务。

（九）本基金管理人于 2007 年 3 月 16 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告，对通过交通银行股份有限公司网上银行申购本基金和广发稳健增长开放式证券投资基金、广发聚富开放式证券投资基金及广发聚丰股票型证券投资基金的投资者给予申购费率（只限前端申购费用）优惠。

（十）本基金管理人于 2007 年 3 月 21 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告，增加国元证券有限责任公司、华安证券有限责任公司、中信金通证券有限责任公司、中信万通证券有限责任公司为本基金的代理销售机构。

（十一）本基金管理人于 2007 年 4 月 20 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布分红公告，每 10 份基金份额派发红利 0.30 元。权益登记日、除息日为 2007 年 4 月 24 日，红利发放日为 2007 年 4 月 26 日。

（十二）本基金管理人于 2007 年 4 月 23 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告，自 2007 年 4 月 23 日——2007 年 9 月 30 日举办 “基金定投 1+1” 活动（详情见公告）。

（十三）本基金管理人于 2007 年 4 月 26 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告，自 2007 年 4 月 26 日起开始在广发华福证券有限责任公司正

式推出本基金的“开放式基金定期定额投资计划”。

(十四) 本基金管理人于 2007 年 5 月 16 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告，增加中国农业银行为本基金的代理销售机构。

(十五) 本基金管理人于 2007 年 5 月 17 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告，增加中原证券股份有限公司为本基金的代理销售机构。

(十六) 本基金管理人于 2007 年 5 月 22 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布分红公告，每 10 份基金份额派发红利 2.00 元。权益登记日、除息日为 2007 年 5 月 24 日，红利发放日为 2007 年 5 月 28 日。

(十七) 本基金管理人于 2007 年 5 月 26 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告，决定自 2007 年 5 月 28 日起，对旗下广发聚富开放式证券投资基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发聚丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金的有效申购申请的申购费用及申购份额的计算统一采用“外扣法”。

(十八) 本基金管理人于 2007 年 6 月 13 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布分红公告，每 10 份基金份额派发红利 1.00 元。权益登记日、除息日为 2007 年 6 月 15 日，红利发放日为 2007 年 6 月 19 日。

(十九) 本基金管理人于 2007 年 6 月 19 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告，对 2007 年 6 月 20 日—2007 年 9 月 28 日通过中国工商银行股份有限公司个人网上银行申购广发聚富开放式证券投资基金、广发稳健增长开放式证券投资基金、广发小盘成长股票型证券投资基金、广发聚丰股票型证券投资基金、广发策略优选混合型证券投资基金的投资者给予申购费率(只限前端申购费用)优惠。

(二十) 本基金管理人于 2007 年 6 月 27 日在《中国证券报》、《证券时报》、《上海证券报》发布公告，于 2007 年 6 月 29 日运用本公司自有资金通过本基金代销机构申购本基金 5000 万元，申购费 1000 元。

(二十一) 本基金的基金管理人、基金托管人涉及托管业务机构及其高级管理人员没有受到任何处罚。

(二十二) 本报告期内，各席位券商股票、国债及回购交易和佣金情况如下：

金额单位：人民币元

1、股票交易及佣金支付情况：

席位名称	租用席位数量	股票交易金额	比例	佣金	比例
广发证券	2	5,333,464,412.38	23.98%	4,314,319.86	24.01%
广发华福	2	2,253,197,916.86	10.13%	1,763,136.33	9.81%
平安证券	1	1,024,766,927.91	4.61%	840,307.06	4.68%
兴业证券	1	1,155,112,488.15	5.19%	903,884.47	5.03%
国元证券	2	2,438,863,297.23	10.97%	1,973,532.97	10.98%
光大证券	2	623,938,623.72	2.81%	492,733.74	2.74%
招商证券	1	1,802,189,311.29	8.10%	1,477,779.04	8.22%
高华证券	1	1,723,884,454.43	7.75%	1,413,569.33	7.87%
东北证券	1	203,030,165.65	0.91%	166,484.90	0.93%
中信证券	1	1,226,569,871.38	5.52%	1,005,787.11	5.60%
国信证券	1	947,074,715.64	4.26%	741,090.23	4.12%
长城证券	1	311,454,223.07	1.40%	255,389.80	1.42%
国泰君安	2	292,018,486.21	1.31%	239,455.32	1.33%
申银万国	1	978,621,085.18	4.40%	802,471.60	4.47%
联合证券	1	786,655,085.47	3.54%	645,053.62	3.59%
银河证券	1	636,823,808.56	2.86%	522,197.50	2.91%
湘财证券	1	500,175,818.15	2.25%	410,143.06	2.28%
合计	22	22,237,840,691.28	100.00%	17,967,335.94	100.00%

2、债券、回购及权证交易情况：

席位名称	席位租用数量	债券交易金额	比例	回购交易金额	比例	权证交易金额	比例
广发证券	2	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
广发华福	2	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
平安证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
兴业证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
国元证券	2	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
光大证券	2	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
招商证券	1	3,507,428.30	100.00%	0.00	0.00%	3,335,856.50	52.91%
高华证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	2,969,250.00	47.09%
东北证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
中信证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
国信证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
长城证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
国泰君安	2	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
申银万国	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
联合证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
银河证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
湘财证券	1	0.00	0.00%	0.00	0.00%	0.00	0.00%
合计	22	3,507,428.30	100.00%	0.00	0.00%	6,305,106.50	100.00%

十、备查文件目录

（一）备查文件目录：

- 1、中国证监会批准广发策略优选混合型证券投资基金募集的文件；
- 2、《广发策略优选混合型证券投资基金基金合同》；
- 3、《广发策略优选混合型证券投资基金托管协议》；
- 4、《广发策略优选混合型证券投资基金招募说明书》及其更新版；
- 5、广发基金管理有限公司批准成立批件、营业执照、公司章程；
- 6、本报告期内在中国证监会指定报纸上公开披露的基金份额净值、投资组合公告及其他临时公告。

（二）存放地点：广州市体育西路 57 号红盾大厦 14 楼、15 楼

（三）查阅方式：

1、书面查询：查阅时间为每工作日 8:30-11:30, 13:00-17:00。

2、网站查询：网址：<http://www.gffunds.com.cn>

投资人对本报告如有疑问，可咨询本基金管理人广发基金管理有限公司，咨询电话：020-83936999，E-mail:services@gffunds.com.cn。

广发基金管理有限公司

二零零七年八月二十九日